

Fecha de Publicación: 31 de octubre de 2016

Fecha de Información: 27 de octubre de jueves <sup>1</sup>

## INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$1488.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.3%.<sup>2</sup>

Cuadro No. 1  
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupa y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	324.9	184.2	112.5	208.3	14.7	59.7	57.0
15-35	375.6	355.7	219.5	98.5	78.7	219.6	57.5
36-60	50.2	52.9	0.0	0.0	52.9	50.2	0.0
61-90	43.1	4.4	0.0	42.6	4.4	0.5	0.0
91-180	30.8	44.1	2.0	0.0	37.1	25.8	5.0
>180	130.2	102.0	5.0	0.0	7.0	40.2	90.0
<b>Total</b>	<b>954.8</b>	<b>743.3</b>	<b>339.0</b>	<b>349.4</b>	<b>194.8</b>	<b>395.9</b>	<b>209.5</b>

\* Cifras en millones de dólares

\*\* Incluye operaciones interbancarias y operaciones con los otros agentes

\*\*\* Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.

Cuadro No. 2

### Devaluación Implícita Ponderada por monto Anualizada

Rango	Sector Financiero*	Otros Agentes sin intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	6.3 %	6.9 %	5.8 %	6.1 %
15-35	6.1 %	7.4 %	6.3 %	6.7 %
36-60	-	6.0 %	5.9 %	6.0 %
61-90	-	6.1 %	5.7 %	6.0 %
91-180	5.3 %	5.5 %	5.2 %	5.4 %
>180	6.0 %	6.2 %	5.5 %	5.9 %
<b>Total</b>	<b>6.1 %</b>	<b>6.9 %</b>	<b>6.0 %</b>	<b>6.3 %</b>

\* Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

<sup>1</sup> Datos provisionales.

<sup>2</sup> El monto negociado diario corresponde a las operaciones de compra y venta evitando la doble contabilización de las operaciones interbancarias. Además, la fórmula para la devaluación implícita es:  $((Tasa\ Pactada/Tasa\ de\ Contado) \wedge (360/Plazo)) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

**Cuadro No. 3**  
**Vencimientos de Forwards**

Sectores	24 al 28 de octubre				31 de oct. al 4 de noviembre				7 al 11 de noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	55	151	4597	3727	31	104	3590	3006	32	78	2187	2033
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	1922	2181	0	0	1333	1514	0	0	894	790
<b>Otros</b>	151	55	815	1408	104	31	796	1198	78	32	702	961
<b>Total</b>	<b>206</b>	<b>206</b>	<b>7335</b>	<b>7317</b>	<b>135</b>	<b>135</b>	<b>5719</b>	<b>5719</b>	<b>109</b>	<b>109</b>	<b>3783</b>	<b>3783</b>

\* Cifras en millones de dólares; No incluye operaciones aceptadas por Cámaras de Riesgo Central de Contraparte.

\*\*Incluye operaciones interbancarias y con otros agentes

\*\*\*Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.